

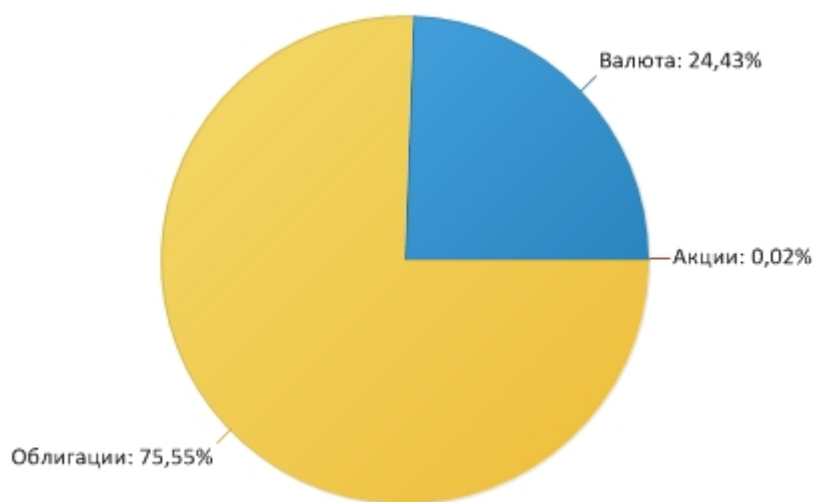
Ежемесячный бюллетень

Период: Май 2014
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"
Правила ДУ: №0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 636		541	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	4,1%	1,4%	12,6%	4,2%
с начала текущего года	-1,9%	-4,6%	-0,8%	-1,9%
за 1 год	1,1%	1,1%	5,1%	5,1%
за 6 месяцев	-1,1%	-2,2%	0,2%	0,4%
за 3 месяца	-1,9%	-7,6%	-0,5%	-2,0%
за месяц	0,1%	1,2%	2,7%	32,4%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0,4		0,7	
Волатильность	3,2%		5,9%	
Максимальное снижение	-4,8%		-7,8%	

* Бенчмарк = 25% Индекс ММБВ + 75% Индекс ММБВ корпоративных облигаций


Структура портфеля по типам инструментов

Структура прибыли и убытков за период

Коэффициент Альфа	0,17	Коэффициент Бета	0,14
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	96 222
Облигации	1 006 010
Прочие доходы и расходы	-50 460
Итого	1 051 772

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	342 210	ЮниКредит Банк обл. БО-08	-177 600
ВымпелКом-Инвест обл. 06	213 000		
Магнит обл. БО-07	145 200		
Магнит аои	91 417		
Русфинанс Банк обл. БО-07	80 100		
Банк Зенит обл. 11	76 800		
Уралвагонзавод НПК обл.01	76 500		
Росбанк обл. БО-6	74 700		
Газпромбанк обл. БО-04	72 200		
Россельхозбанк обл. 03	69 200		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Магнит обл. БО-07	11,69%	21.09.2015	9,44%
ЮниКредит Банк обл. БО-08	11,67%	23.02.2016	9,84%
Норильский никель обл. БО-02	11,49%	25.02.2016	9,70%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	11,48%	13.10.2015	9,81%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	9,69%	13.03.2020	9,67%
Банк Зенит обл. 11	8,67%	16.10.2018	10,39%
Уралвагонзавод НПК обл.01	6,02%	07.12.2017	9,15%
Газпромбанк обл. БО-04	6,00%	20.12.2014	8,16%
Росбанк обл. БО-6	5,91%	30.01.2016	9,40%
Русфинанс Банк обл. БО-07	5,84%	24.04.2018	10,08%
Россельхозбанк обл. 03	5,83%	09.02.2017	5,89%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	5,72%	13.10.2015	10,12%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
Магнит аои	100,00%	▲ +26,51